

Pubblicazioni PlayOptions



Strategia Stop e Reverse

Strategist Cagalli Tiziano

Disclaimer

I pensieri e le analisi qui esposte non sono un servizio di consulenza o sollecitazione al pubblico risparmio. I suddetti servizi non sono configurabili come rapporto di consulenza né di gestione finanziaria che prevede sempre lo studio delle esigenze finanziarie del cliente e della sua propensione al rischio.

L'articolo ha valore esclusivamente informativo e chi scrive non potrà mai e in nessuna forma essere ritenuto responsabile delle conseguenze derivanti dall'uso che il lettore, in totale autonomia ed indipendenza, potrà fare dei dati ottenuti mediante la consultazione del servizio stesso.

Tutte le analisi, le valutazioni e i commenti non intendono assolutamente promuovere alcuna forma di investimento o speculazione. Sono e vogliono essere esclusivamente studi matematici applicati a valori e materiale puramente didattico.

Le strategie consistono nello studiare delle aree di guadagno e di perdita e costruirle con gli strumenti che i derivati mettono a disposizione.

Il problema nasce quando non si ha la possibilità di modificare il progetto iniziale e questo è più importante in momenti in cui il trend non è definito cioè quando gli equilibri finanziari sono instabili.

Ecco l'importanza di avere una strategia flessibile che permetta di stoppare quella in atto e fare il reverse del progetto.

Nel video inizio ad illustrare la procedura per questa costruzione.

La strategia verrà riportata e discussa nel forum di PlayOptions.it e sarà anche l'argomento dell'ultimo Tour dell'anno che faremo a Milano il 18/12.

Useremo FiutoPro e l'indicatore Parabolic Sar Extended il sottostante è il Bund.

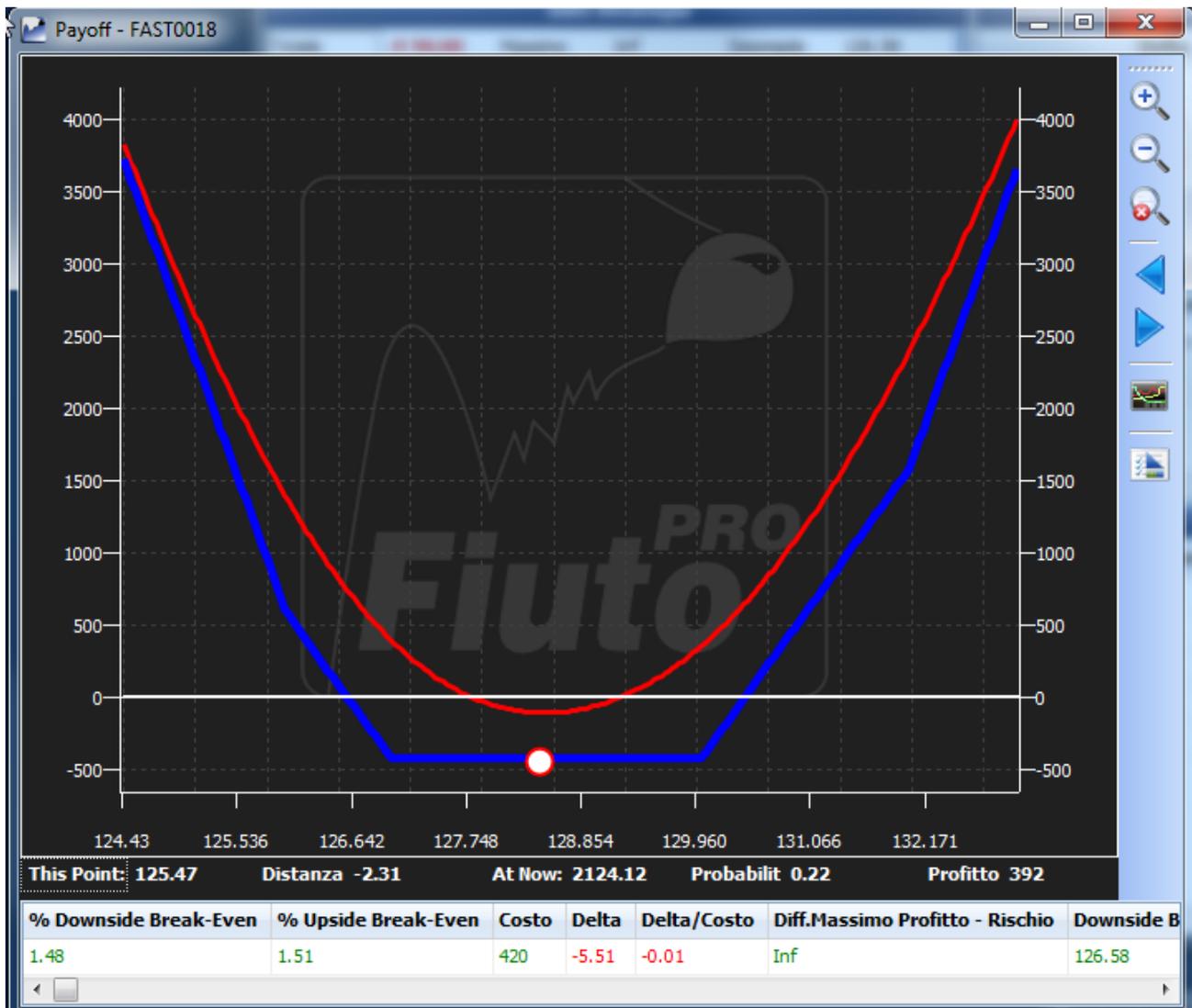
Questa strategia richiederà anche l'utilizzo del future.

Prima fase:

l'extend mi da segnale Short



Costruisco allora un Strangle asimmetrico che abbia leggermente più spazio verso la salita.



Editor Strategia

Bund Stop Reverse

Dati Strategia						Hedging				
Totale	-€ 90.00	Massimo	Inf	Downside	126.58					
Totale	€ 0.00	Probabilita'	7.62	Upside	130.42	Attiva	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Massimo	Inf	Credito -	-420	% Downside	1.48	Portafoglio	-5.51	424.3	-39.71	163.8
Massimo	-420	Giorni a	13	% Upside	1.51	Da Proteggere	-5.51	424.3	-39.71	163.8

Sottostanti

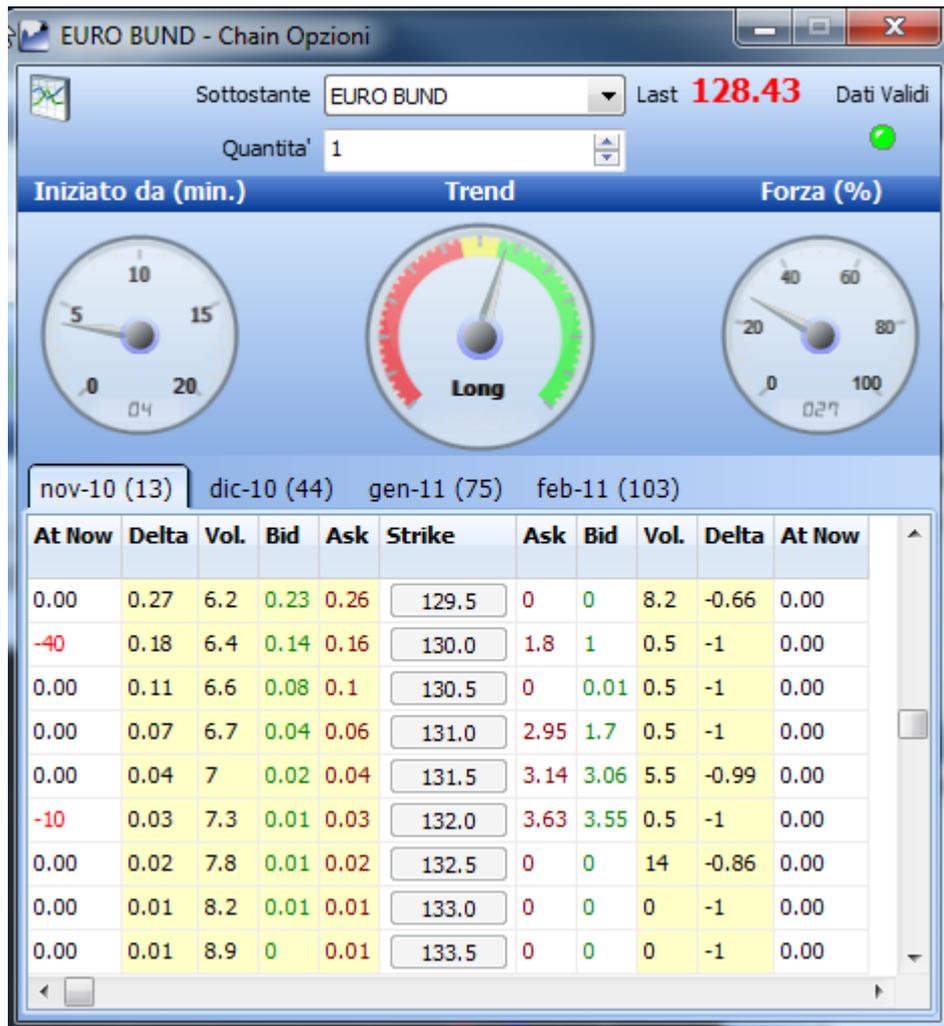
+	Edit	Buy/Sell	Nome	Q.ta'	Q.ta' Hedging	Last	Riferimento	Prezzo Medio di Carico
-	Edit	Buy/Sell	EURO BUND	0	0	128.44	128.44	0
+								

Opzioni

+	Edit	Buy/Sell	Nome	Q.ta'	Bid	Ask	Prezzo Medio di Carico	Vol.	Delta	Spre
-	Edit	Buy/Sell	C @ 130 11-2010	1	0.14	0.16	0.18	6.5	0.17	12.5
-	Edit	Buy/Sell	C @ 132 11-2010	1	0.01	0.03	0.02	6.74	0.02	66.67
-	Edit	Buy/Sell	P @ 127 11-2010	1	0.14	0.16	0.17	6.24	-0.17	12.5
-	Edit	Buy/Sell	P @ 126 11-2010	1	0.03	0.05	0.05	6.09	-0.05	40
+										

Il motivo è che voglio avere più possibilità di vendere Theta nella direzione di salita dato che il trend è in discesa.

Per andare a mercato utilizzo gli strumenti del Fast Book di Fiiuto Pro.



Ora aspettiamo i movimenti del mercato per procedere oltre.

Buon trading
Tiziano Cagalli

Invito chi non conosce questi strumenti a prenderne visione e magari a leggere sul mio sito (www.PlayOptions.it) la sezione didattica.

Scarica gratuitamente, per sempre, il software per costruire le tue strategie in opzioni

